

**ФГБОУ ВО НОВОСИБИРСКИЙ ГАУ**  
**Кафедра учета и финансовых технологий**

Рег. № \_\_\_\_\_  
«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

**УТВЕРЖДЕН**  
на заседании кафедры  
Протокол от «\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г. № \_\_\_\_\_  
И.о. заведующего кафедрой учета и  
финансовых технологий  
\_\_\_\_\_ О.С. Шинделова  
(подпись)

**ФОНД**  
**ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

**Б1.В.20 Фундаментальный и технический анализ**

Шифр и наименование дисциплины

**38.03.01 Экономика**

Код и наименование направления подготовки

**Финансовые рынки и цифровые финансовые технологии**

Направленность (профиль)

Новосибирск 2022

**Паспорт фонда оценочных средств**

№	Контролируемые разделы (темы)	Код контролируемой	Наименование
---	-------------------------------	--------------------	--------------

п/п	дисциплины	компетенции (или ее части)	оценочного средства
1	Рынок ценных бумаг как объект анализа	ПК-1,2	Дискуссия
2	Методика фундаментального анализа акций	ПК-1,2	Дискуссия
3	Модели оценки справедливой стоимости ценных бумаг	ПК-1,2	Дискуссия
4	Оценка доходности и риска портфеля ценных бумаг	ПК-1,2	Дискуссия
5	Основы технического анализа рынка ценных бумаг	ПК-1,2	Дискуссия
6	Графики как инструмент технического анализа	ПК-1,2	Дискуссия
7	Методика технического анализа графиков движения рыночных цен	ПК-1,2	Дискуссия
8	Анализ фондовых индикаторов, волн и циклов	ПК-1,2	Дискуссия

**МАТРИЦА СООТВЕТСТВИЯ КРИТЕРИЕВ ОЦЕНКИ УРОВНЮ  
СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ**

Критерии оценки	Уровень сформированности компетенций
<b>Оценка по пятибалльной системе</b>	
«Отлично»	«Высокий уровень»
«Хорошо»	«Повышенный уровень»
«Удовлетворительно»	«Пороговый уровень»
«Неудовлетворительно»	«Не достаточный»
<b>Оценка по системе «зачет – незачет»</b>	
«Зачтено»	«Достаточный»
«Не зачтено»	«Не достаточный»

**Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений,  
навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования  
компетенций**

1. Положение «О балльно-рейтинговой системе аттестации студентов»: СМК ПНД 08-01-2015, введено приказом от 28.09.2011 №371-О, утверждено ректором 12.10.2015 г. (<http://nsau.edu.ru/file/403>: режим доступа свободный);

2. Положение «О проведении текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся в ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ»: СМК ПНД 77-01-2015, введено в действие приказом от 03.08.2015 №268а-О (<http://nsau.edu.ru/file/104821>: режим доступа свободный).

Составитель \_\_\_\_\_ С.Н. Матвиенко  
(подпись)

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ  
Кафедра учета и финансовых технологий  
(наименование кафедры)

**Дискуссия**  
по дисциплине Фундаментальный и технический анализ  
(наименование дисциплины)

Тема 1. Рынок ценных бумаг как объект анализа

1. Понятие и сущность рынка ценных бумаг.
2. Виды и классификация ценных бумаг.

Тема 2. Методика фундаментального анализа акций

1. Макроэкономический анализ.
2. Отраслевой анализ.
3. Фундаментальный анализ операций с акциями конкретного эмитента.

Тема 3. Модели оценки справедливой стоимости ценных бумаг

1. Модель капитализации дохода.
2. Модель нулевого роста.
3. Модель постоянного роста.
4. Модель переменного роста.
5. Оценка с учётом конечного срока владения.
6. Модели, основанные на соотношении «цена-доход».

Тема 4. Оценка доходности и риска портфеля ценных бумаг

1. Расчёт доходности портфеля ценных бумаг.
2. Оценка риска портфеля ценных бумаг.

Тема 5. Основы технического анализа рынка ценных бумаг

1. Зарождение технического анализа.
2. Основные принципы технического анализа.
3. Теория Доу.

Тема 6. Графики как инструмент технического анализа

1. Линейные графики.
2. Графики в виде «баров».
3. «Японские свечи».
4. Графики типа «крестики-нолики».
5. Графики объёма торгов.

Тема 7. Методика технического анализа графиков движения рыночных цен

1. Основные понятия, используемые при анализе графиков.
2. Анализ линий тренда.
3. Анализ моделей продолжения (консолидации).
4. Анализ моделей разворота.
5. Определение уровней поддержки и сопротивления.
6. Анализ скользящих средних.
7. Определение индекса относительной эффективности.
8. Анализ разрывов.

Тема 8. Анализ фондовых индикаторов, волн и циклов

1. Основные фондовые индикаторы.
2. Теории волн, циклов.

### **Критерии оценки:**

– отметка **«отлично»** выставляется студенту, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, причем не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, использует в ответе материал монографической литературы, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач.

– отметка **«хорошо»** выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.

– отметка **«удовлетворительно»** выставляется обучающемуся, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, демонстрирует недостаточно систематизированные теоретические знания программного материала, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при выполнении практических работ.

– отметка **«неудовлетворительно»** выставляется обучающемуся, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки при его изложении, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы.

Составитель \_\_\_\_\_ С.Н. Матвиенко  
(подпись)

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ  
Кафедра учета и финансовых технологий  
(наименование кафедры)

**Тестовые задания**  
по дисциплине Фундаментальный и технический анализ  
(наименование дисциплины)

1. Укажите авторов теории независимости дивидендов:
  - А. Ф. Модильяни
  - В. М. Миллер
  - С. М. Гордон
  - Д. Д. Линтнер
2. Укажите авторов теории предпочтительности дивидендов:
  - А. Ф. Модильяни
  - В. М. Миллер
  - С. М. Гордон
  - Д. Д. Линтнер
3. Акция – это
  - А. Долевая ценная бумага
  - В. Долговая ценная бумага
4. Облигация – это
  - А. Долевая ценная бумага
  - В. Долговая ценная бумага

**Критерии оценки:**

- оценка «отлично» выставляется студенту, если он отвечает верно на 80-100% вопросов.
- оценка «хорошо», выставляется студенту, если он отвечает верно на 70-79% вопросов.
- оценка «удовлетворительно», выставляется студенту, если он отвечает верно на 60-69% вопросов.
- оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если он не освоил материал темы, дает менее 60% правильных ответов.

Составитель \_\_\_\_\_ С.Н. Матвиенко  
(подпись)

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ  
Кафедра учета и финансовых технологий  
(наименование кафедры)

**Список вопросов для подготовки к экзамену**

1. Понятие и сущность рынка ценных бумаг.
2. Виды и классификация ценных бумаг.
3. Макроэкономический анализ.
4. Отраслевой анализ.
5. Фундаментальный анализ операций с акциями конкретного эмитента.
6. Модели оценки справедливой стоимости ценных бумаг
7. Модель капитализации дохода.
8. Модель нулевого роста.
9. Модель постоянного роста.
10. Модель переменного роста.
11. Оценка с учётом конечного срока владения.
12. Модели, основанные на соотношении «цена-доход».
13. Расчёт доходности портфеля ценных бумаг.
14. Оценка риска портфеля ценных бумаг.
15. Зарождение технического анализа.
16. Основные принципы технического анализа.
17. Теория Доу.
18. Графики как инструмент технического анализа
19. Линейные графики.
20. Графики в виде «баров».
21. «Японские свечи».
22. Графики типа «крестики-нолики».
23. Графики объёма торгов.
24. Методика технического анализа графиков движения рыночных цен
25. Основные понятия, используемые при анализе графиков.
26. Анализ линий тренда.
27. Анализ моделей продолжения (консолидации).
28. Анализ моделей разворота.
29. Определение уровней поддержки и сопротивления.
30. Анализ скользящих средних.
31. Определение индекса относительной эффективности.
32. Анализ разрывов.
33. Основные фондовые индикаторы.
34. Теории волн, циклов.

**Критерии оценки:**

– отметка **«отлично»** выставляется студенту, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, причем не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, использует в ответе материал монографической литературы, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач.

– отметка **«хорошо»** выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.

– отметка **«удовлетворительно»** выставляется обучающемуся, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, демонстрирует недостаточно систематизированные теоретические знания программного материала, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при выполнении практических работ.

– отметка **«неудовлетворительно»** выставляется обучающемуся, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки при его изложении, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы.

Составитель \_\_\_\_\_ С.Н. Матвиенко  
(подпись)

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ  
Кафедра учета и финансовых технологий  
(наименование кафедры)

**Темы курсовых работ**

1. Макроэкономический анализ.
2. Отраслевой анализ.
3. Фундаментальный анализ операций с акциями конкретного эмитента.
4. Модели оценки справедливой стоимости ценных бумаг
5. Расчёт доходности и оценка риска портфеля ценных бумаг.
6. Зарождение технического анализа. Основные принципы технического анализа.
7. Графики как инструмент технического анализа
8. Методика технического анализа графиков движения рыночных цен
9. Основные фондовые индикаторы.
10. Теории волн, циклов.

Составитель \_\_\_\_\_ С.Н. Матвиенко  
(подпись)

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

## Тестовые задания для итоговой проверки уровня сформированности компетенций по дисциплине «Фундаментальный и технический анализ»

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

### Формируемые компетенции:

1. ПК-1. Способен разрабатывать планы мероприятий в части финансовой деятельности организации, обеспечивать их реализацию во взаимодействии с ее структурными подразделениями и иными заинтересованными лицами

1. Рентабельность активов составляет 25%, средняя расчётная ставка процента 10%, заёмный капитал 600 тыс. руб., собственный капитал 400 тыс. руб. Рассчитайте дифференциал финансового рычага.

A. 15%.

B. 35%

C. 0,67

D. 1,5

2. Рассчитайте коэффициент финансовой устойчивости. Собственный капитал равен 130 тыс. руб. Долгосрочные обязательства – 50 тыс. руб., краткосрочные обязательства – 20 тыс. руб.

A. 0,65.

B. 0,9.

C. 0,54.

D. 1,86.

По ПК-1 получены результаты: \_\_\_\_\_

2. ПК-2. Способен осуществлять отбор поставщиков финансовых услуг в соответствии с выделенными критериями

1. Рассчитайте средний срок оборачиваемости активов (в году 360 дней). Выручка – 200 тыс. руб., активы – 50 тыс. руб.

A. 30.

B. 60.

C. 90.

D. 120.

2. Рассчитайте рентабельность собственного капитала (по чистой прибыли). Прибыль от продаж равна 170 тыс. руб., до налогообложения 120 тыс. руб., чистая прибыль составила 96 тыс. руб. Выручка равна 500 тыс. руб., себестоимость продаж равна 350 тыс. руб., активы составили 400 тыс. руб., собственный капитал равен 300 тыс. руб.

A. 34%.

B. 48,6%.

C. 30%.

D. 32%.

По ПК-2 получены результаты: \_\_\_\_\_

Критерии оценки результатов тестирования:

– оценка «отлично» выставляется студенту, если он отвечает верно на 80-100% вопросов.

– оценка «хорошо», выставляется студенту, если он отвечает верно на 70-79% вопросов.

– оценка «удовлетворительно», выставляется студенту, если он отвечает верно на 60-69% вопросов.

– оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если он не освоил материал темы, дает менее 60% правильных ответов.

**Итого количество баллов по дисциплине \_\_\_\_\_**

Составитель \_\_\_\_\_ С.Н. Матвиенко  
(подпись)

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.